

# 富安达中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
§4 管理人报告 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
§5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
§6 审计报告 .....	14
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	14
§7 年度财务报表 .....	17
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
§8 投资组合报告 .....	49
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	59

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
§9 基金份额持有人信息 .....	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
§10 开放式基金份额变动 .....	62
§11 重大事件揭示 .....	62
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
§13 备查文件目录 .....	74
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证500指数增强型证券投资基金
基金简称	富安达中证500指数增强
基金主代码	007943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月19日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,499,339.69份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平。
投资策略	<p>本基金股票投资比例范围为基金资产的90%—95%。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。基金以量化评估因子为基础，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>本基金以中证500指数为标的指数，通过量化组合管理方法，从优选个股、风险控制、成本控制等角度优化投资组合，力争在稳定跟踪标的指数外获取超额收益。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场

	基金。同时，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李理想	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		张睿	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年11月19日（基金合同生效日）-2019年12月31日
本期已实现收益	6,408,115.85	11,863,148.43	229,938.40
本期利润	5,452,016.38	11,435,102.18	1,985,282.87
加权平均基金份额本期利润	0.2049	0.1648	0.0067
本期加权平均净值利润率	15.81%	15.52%	0.67%
本期基金份额净值增长率	15.62%	20.69%	0.67%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	7,083,899.82	9,174,322.00	229,938.40
期末可供分配基金份额利润	0.4048	0.2150	0.0008
期末基金资产净值	24,583,239.51	51,850,089.60	299,152,763.59
期末基金份额净值	1.4048	1.2150	1.0067
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	40.48%	21.50%	0.67%

注：

- ①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- ②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- ③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.92%	0.72%	3.43%	0.72%	-4.35%	0.00%
过去六个月	6.55%	0.97%	7.72%	0.91%	-1.17%	0.06%
过去一年	15.62%	0.99%	14.83%	0.92%	0.79%	0.07%
自基金合同 生效起至今	40.48%	1.22%	47.76%	1.24%	-7.28%	-0.02%

注：

1. 本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后），

2. 本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 95\% \times [\text{中证500指数收益率}_t \div \text{中证500指数收益率}_{(t-1)} - 1] + 5\% \times [\text{商业银行活期存款利率（税后）}_t \div \text{商业银行活期存款利率（税后）}_{(t-1)} - 1]$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times \text{Benchmark}_{(t-1)}$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

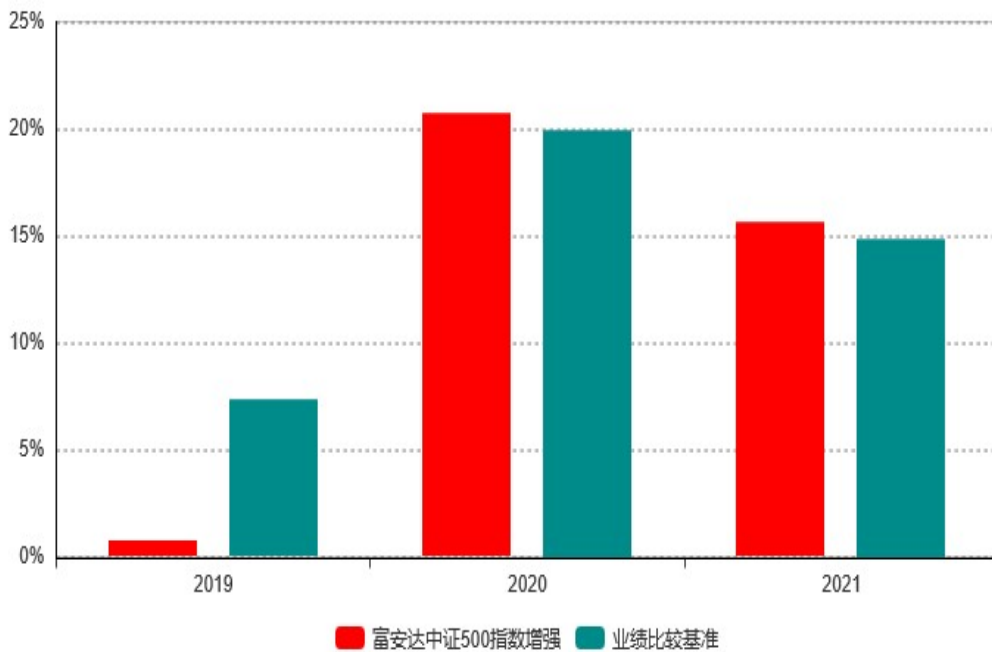


富安达中证500指数增强型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月19日-2021年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2019年11月19日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2019年11月19日，自基金合同生效日至本报告期末无利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2021年12月31日，公司共管理十八只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安成长价值一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主持工作）	2019-11-19	-	13 年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年4月加入富安达基金管理有限公司。2016年12月起担任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金（2016年12月16日至2021年11月03日期间）、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：

1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年A股市场白马龙头行情于年初见顶后，板块间轮动速度显著加快，在全球新冠疫情反复的环境下，国外产能供给受限叠加经济复苏带动大宗商品价格快速上涨等因素，商品板块出现业绩和估值的双击行情，而双碳主题则是贯穿全年的核心。本基金以量化增强策略为配置基础，坚持以优选“业绩持续成长、估值具备优势”的个股为基础策略，同时坚持多维度控制组合相对中证500指数的偏离风险的量化风控体系，力争在震荡行情中获取相对稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证500指数增强基金份额净值为1.4048元，本报告期内，基金份额净值增长率为15.62%，同期业绩比较基准收益率为14.83%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2022年，市场所面临的宏观经济环境较为复杂，美国通胀压力导致利率上行概率大增，而我国目前处于跨周期调节阶段，故国内流动性相对宽松，这样截然相反的政策环境使得对于成长板块的定价难度增加。在成长板块估值仍然处于较高水平的情况下，预计较难出现板块性机会，而资金倾向于投向估值仍处历史较低水平且受益于“稳增长”预期的价值风格板块，且2022年疫情影响全面结束的预期也愈来愈强，近两年因疫情受损的行业如酒店、航空等可选消费板块也存在一定的复苏预期。

### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规

性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部指派人员组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人富安达中证500指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达中证500指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22556号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富安达中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了富安达中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“富安达中证500指数基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有

	<p>重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了富安达中证500指数基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于富安达中证500指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>富安达中证500指数基金的基金管理人富安达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估富安达中证500指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算富安达中证500指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督富安达中证500指数基金的财务报告过程。富安达中证500指数基金的基金管理人富安达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准</p>

	<p>则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估富安达中证500指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算富安达中证500指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督富安达中证500指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获</p>



	取的审计证据，就可能导致对富安达中证500指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富安达中证500指数基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹、林佳璐
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2022-03-23

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,467,313.13	3,659,541.02
结算备付金		103,273.09	334,319.15
存出保证金		6,052.13	666,343.62
交易性金融资产	7.4.7.2	23,277,033.48	40,725,854.40

其中：股票投资		23,277,033.48	40,725,854.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,082,282.93	-
应收利息	7.4.7.5	350.20	772.24
应收股利		-	-
应收申购款		3,013.91	7,123,121.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,939,318.87	52,509,951.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	265,758.59
应付赎回款		2,133,436.92	58,622.27
应付管理人报酬		17,191.70	27,709.63
应付托管费		3,438.34	5,541.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	61,928.67	77,123.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	140,083.73	225,106.46
负债合计		2,356,079.36	659,862.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	17,499,339.69	42,675,767.60
未分配利润	7.4.7.10	7,083,899.82	9,174,322.00
所有者权益合计		24,583,239.51	51,850,089.60
负债和所有者权益总计		26,939,318.87	52,509,951.68

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.4048元，基金份额总额17,499,339.69份。

## 7.2 利润表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
<b>一、收入</b>		6,598,784.65	13,822,342.88
1. 利息收入		19,061.86	180,133.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,061.86	99,090.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	81,043.10
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,464,760.38	13,111,871.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,933,137.16	12,579,496.32

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	92,427.18	-82,920.00
股利收益	7.4.7.16	439,196.04	615,294.87
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-956,099.47	-428,046.25
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	71,061.88	958,384.12
<b>减：二、费用</b>		1,146,768.27	2,387,240.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	260,208.60	565,306.26
2. 托管费	7.4.10.2. 2	52,041.75	113,061.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	543,965.19	1,333,363.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		332.73	-
7. 其他费用	7.4.7.20	290,220.00	375,510.00
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		5,452,016.38	11,435,102.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		5,452,016.38	11,435,102.18

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	42,675,767.60	9,174,322.00	51,850,089.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,452,016.38	5,452,016.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-25,176,427.91	-7,542,438.56	-32,718,866.47
其中：1. 基金申购款	3,463,115.76	1,276,599.82	4,739,715.58
2. 基金赎回款	-28,639,543.67	-8,819,038.38	-37,458,582.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	17,499,339.69	7,083,899.82	24,583,239.51
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	297,167,480.72	1,985,282.87	299,152,763.59

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,435,102.18	11,435,102.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-254,491,713.12	-4,246,063.05	-258,737,776.17
其中：1. 基金申购款	36,055,178.57	6,505,284.14	42,560,462.71
2. 基金赎回款	-290,546,891.69	-10,751,347.19	-301,298,238.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	42,675,767.60	9,174,322.00	51,850,089.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

张睿

孙爱民

顾颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富安达中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1329号《关于准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由富安达基金管理有限公司(以下简称“富安达基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币297,120,955.39元,业经毕马威华振会计师事

务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1900474号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年11月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为297,167,480.72份基金份额,其中认购资金利息折合46,525.33份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(股指期货、国债期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金(不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2022年3月23日批准报出

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2021年12月31日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金

的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。



对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	1,467,313.13	3,659,541.02
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,467,313.13	3,659,541.02

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,905,834.73	23,277,033.48	371,198.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,905,834.73	23,277,033.48	371,198.75
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,448,996.18	40,725,854.40	1,276,858.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,448,996.18	40,725,854.40	1,276,858.22

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,755,840.00	-	-	-
—股指期货	3,755,840.00	-	-	IC2101
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,755,840.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于

2020年12月31日，本基金持有3手中证500指数期货IC2101，合约市值为3,806,280.00元。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	300.76	611.64
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	46.50	51.50
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.14	100.50
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	2.80	8.60
合计	350.20	772.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2021年12月31日	2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	61,928.67	77,123.19
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	61,928.67	77,123.19

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	83.73	106.46
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	90,000.00	175,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	140,083.73	225,106.46

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,675,767.60	42,675,767.60
本期申购	3,463,115.76	3,463,115.76
本期赎回（以“-”号填列）	-28,639,543.67	-28,639,543.67
本期末	17,499,339.69	17,499,339.69

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,809,321.65	-1,634,999.65	9,174,322.00
本期利润	6,408,115.85	-956,099.47	5,452,016.38



本期基金份额交易产生的变动数	-8,127,451.99	585,013.43	-7,542,438.56
其中：基金申购款	1,421,827.68	-145,227.86	1,276,599.82
基金赎回款	-9,549,279.67	730,241.29	-8,819,038.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,089,985.51	-2,006,085.69	7,083,899.82

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	16,460.28	47,489.39
定期存款利息收入	-	23,965.50
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,107.47	25,925.30
其他	494.11	1,710.53
合计	19,061.86	99,090.72

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	196,361,294.55	487,121,346.02
减：卖出股票成本总额	189,428,157.39	474,541,849.70
买卖股票差价收入	6,933,137.16	12,579,496.32

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
股指期货投资收益	92,427.18	-82,920.00

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	439,196.04	615,294.87
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	439,196.04	615,294.87

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-905,659.47	-478,486.25
——股票投资	-905,659.47	-478,486.25

——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-50,440.00	50,440.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-50,440.00	50,440.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-956,099.47	-428,046.25

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	71,041.62	909,031.26
转换费收入	20.26	49,352.86
合计	71,061.88	958,384.12

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	543,791.80	1,332,654.31

银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	173.39	708.78
合计	543,965.19	1,333,363.09

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	220.00	510.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	290,220.00	375,510.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司(“富安达基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司(“南京证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏云杉资本管理有限公司(“江苏云杉”)	基金管理人的股东
江苏交通控股有限公司	基金管理人的原股东
南京市河西新城国有资产经营控股(集团)有限责任公司(“南京河西”)	基金管理人的股东

富安达资产管理(上海)有限公司(“富安达资管”)	基金管理人的全资子公司
--------------------------	-------------

注：1. 2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，基金管理人股东江苏交通控股有限公司将其持有的本公司26%股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。本次股权变更事项已经完成工商变更登记手续。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
南京证券	39,398,266.23	10.71%	424,470,928.06	46.60%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例

南京证券	-	-	501,000,000.00	100.00%
------	---	---	----------------	---------

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	36,691.29	11.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	395,310.49	51.69%	44,521.95	57.73%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	260,208.60	565,306.26
其中：支付销售机构的客户维护费	30,973.63	92,569.16

注：

1. 支付基金管理人富安达基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数。}$$

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	52,041.75	113,061.35

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
富安达资管	8,499,000.00	48.57%	9,999,000.00	23.43%

注：基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,467,313.13	16,460.28	3,659,541.02	47,489.39

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元



7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股锁定	4.53	4.27	157,604	713,946.12	672,969.08	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险

和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年12月31日，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理

人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,467,313.13	-	-	-	1,467,313.13
结算备付金	103,273.09	-	-	-	103,273.09
存出保证金	6,052.13	-	-	-	6,052.13
交易性金融资产	-	-	-	23,277,033.48	23,277,033.48
应收证券清算款	-	-	-	2,082,282.93	2,082,282.93
应收利息	-	-	-	350.20	350.20
应收申	-	-	-	3,013.91	3,013.91

## 富安达中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告

购款					
资产总计	1,576,638.35	-	-	25,362,680.52	26,939,318.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,133,436.92	2,133,436.92
应付管理人报酬	-	-	-	17,191.70	17,191.70
应付托管费	-	-	-	3,438.34	3,438.34
应付交易费用	-	-	-	61,928.67	61,928.67
其他负债	-	-	-	140,083.73	140,083.73
负债总计	-	-	-	2,356,079.36	2,356,079.36
利率敏感度缺口	1,576,638.35	-	-	23,006,601.16	24,583,239.51
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,659,541.02	-	-	-	3,659,541.02
结算备付金	334,319.15	-	-	-	334,319.15
存出保证金	666,343.62	-	-	-	666,343.62
交易性金融资产	-	-	-	40,725,854.40	40,725,854.40
应收利息	-	-	-	772.24	772.24
应收申购款	5,023,850.89	-	-	2,099,270.36	7,123,121.25
资产总计	9,684,054.68	-	-	42,825,897.00	52,509,951.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	265,758.59	265,758.59
应付赎回	-	-	-	58,622.27	58,622.27

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	27,709.63	27,709.63
应付托管费	-	-	-	5,541.94	5,541.94
应付交易费用	-	-	-	77,123.19	77,123.19
其他负债	-	-	-	225,106.46	225,106.46
负债总计	-	-	-	659,862.08	659,862.08
利率敏感度缺口	9,684,054.68	-	-	42,166,034.92	51,850,089.60

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格

实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,277,033.48	94.69	40,725,854.40	78.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,277,033.48	94.69	40,725,854.40	78.55

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中证500指数上升5%	972,863.61	2,112,450.07

	2. 中证500指数下降5%	-972,863.61	-2,112,450.07
--	----------------	-------------	---------------

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的 $\beta$ 系数为股票组合的 $\beta$ 系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的 $\beta$ 加权平均。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为22,604,064.40元，属于第三层次的余额为672,969.08元，无属于第二层次的余额(2020年12月31日：第一层次40,718,346.60元，第二层次7,507.80元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具672,969.08元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具713,946.12元(2020年度：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动-40,977.04元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资)公允价值为672,969.08元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率，与公允价值之间为负相关关系。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具



于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,277,033.48	86.41
	其中：股票	23,277,033.48	86.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,570,586.22	5.83
8	其他各项资产	2,091,699.17	7.76
9	合计	26,939,318.87	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	266,812.00	1.09
B	采矿业	1,089,058.00	4.43

C	制造业	11,077,421.00	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	798,611.00	3.25
E	建筑业	652,027.00	2.65
F	批发和零售业	649,775.00	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	705,020.00	2.87
H	住宿和餐饮业	76,180.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	951,147.00	3.87
J	金融业	1,352,731.00	5.50
K	房地产业	738,545.00	3.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	253,339.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	276,200.00	1.12
S	综合	-	-
	合计	18,886,866.00	76.83

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,952,813.00	12.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	62,790.00	0.26

F	批发和零售业	114,559.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	672,969.08	2.74
J	金融业	196,986.00	0.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	111,186.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	163,127.40	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	115,737.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	4,390,167.48	17.86

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601689	拓普集团	6,100	323,300.00	1.32
2	600862	中航高科	8,900	318,264.00	1.29
3	600642	申能股份	42,600	313,962.00	1.28
4	002152	广电运通	25,700	305,830.00	1.24

5	603290	斯达半导	800	304,800.00	1.24
6	600372	中航电子	13,500	302,265.00	1.23
7	601615	明阳智能	11,000	287,100.00	1.17
8	601456	国联证券	19,500	272,415.00	1.11
9	601699	潞安环能	23,700	268,047.00	1.09
10	600446	金证股份	18,400	263,488.00	1.07
11	603868	飞科电器	5,900	256,178.00	1.04
12	600377	宁沪高速	28,100	242,222.00	0.99
13	605358	立昂微	2,000	240,020.00	0.98
14	603707	健友股份	5,600	235,200.00	0.96
15	600803	新奥股份	12,000	220,320.00	0.90
16	600567	山鹰国际	62,500	205,625.00	0.84
17	002926	华西证券	20,500	201,925.00	0.82
18	600967	内蒙一机	15,400	184,030.00	0.75
19	601717	郑煤机	15,700	181,963.00	0.74
20	300037	新宙邦	1,600	180,800.00	0.74
21	600884	杉杉股份	5,500	180,235.00	0.73
22	000729	燕京啤酒	20,600	174,482.00	0.71
23	002797	第一创业	23,200	169,824.00	0.69
24	002191	劲嘉股份	11,200	169,456.00	0.69
25	600256	广汇能源	25,700	168,078.00	0.68
26	600201	生物股份	10,200	166,770.00	0.68
27	002013	中航机电	9,100	165,438.00	0.67
28	002273	水晶光电	9,400	163,466.00	0.66
29	000999	华润三九	4,700	160,928.00	0.65
30	000970	中科三环	10,000	160,500.00	0.65
31	600170	上海建工	44,300	159,480.00	0.65
32	300285	国瓷材料	3,700	157,509.00	0.64
33	601636	旗滨集团	9,200	157,320.00	0.64
34	002299	圣农发展	6,500	157,105.00	0.64
35	600195	中牧股份	11,900	155,533.00	0.63

36	688122	西部超导	1,600	155,104.00	0.63
37	600536	中国软件	3,100	154,783.00	0.63
38	601168	西部矿业	11,300	153,793.00	0.63
39	002185	华天科技	12,100	153,791.00	0.63
40	600728	佳都科技	18,400	153,272.00	0.62
41	600066	宇通客车	13,700	150,974.00	0.61
42	002028	思源电气	3,000	147,630.00	0.60
43	600271	航天信息	11,000	147,290.00	0.60
44	000598	兴蓉环境	23,200	146,624.00	0.60
45	603198	迎驾贡酒	2,100	145,845.00	0.59
46	603605	珀莱雅	700	145,817.00	0.59
47	600380	健康元	11,300	145,092.00	0.59
48	600486	扬农化工	1,100	144,320.00	0.59
49	600282	南钢股份	38,800	143,560.00	0.58
50	002372	伟星新材	5,900	143,488.00	0.58
51	300630	普利制药	2,600	143,104.00	0.58
52	601200	上海环境	11,300	142,267.00	0.58
53	002424	贵州百灵	18,700	142,120.00	0.58
54	000961	中南建设	34,300	142,002.00	0.58
55	002056	横店东磁	7,500	141,525.00	0.58
56	600765	中航重机	2,800	141,372.00	0.58
57	002867	周大生	7,900	140,462.00	0.57
58	603077	和邦生物	41,000	139,810.00	0.57
59	000997	新大陆	7,700	139,524.00	0.57
60	600064	南京高科	14,900	139,166.00	0.57
61	601928	凤凰传媒	17,200	139,148.00	0.57
62	000039	中集集团	8,100	138,996.00	0.57
63	600998	九州通	9,400	138,368.00	0.56
64	600908	无锡银行	24,400	138,348.00	0.56
65	002156	通富微电	7,100	137,953.00	0.56
66	000156	华数传媒	16,200	137,052.00	0.56

67	300474	景嘉微	900	136,980.00	0.56
68	603893	瑞芯微	1,000	136,900.00	0.56
69	600704	物产中大	23,100	136,752.00	0.56
70	603858	步长制药	6,400	134,976.00	0.55
71	600787	中储股份	21,500	134,160.00	0.55
72	000050	深天马 A	10,300	134,106.00	0.55
73	000778	新兴铸管	30,800	133,364.00	0.54
74	600325	华发股份	22,100	133,042.00	0.54
75	000750	国海证券	32,300	132,753.00	0.54
76	600546	山煤国际	16,100	132,181.00	0.54
77	600988	赤峰黄金	8,800	131,120.00	0.53
78	000090	天健集团	22,200	130,314.00	0.53
79	600667	太极实业	15,600	126,048.00	0.51
80	600835	上海机电	7,900	125,768.00	0.51
81	000060	中金岭南	25,500	125,205.00	0.51
82	601958	金钼股份	18,100	123,985.00	0.50
83	000878	云南铜业	9,200	123,004.00	0.50
84	002244	滨江集团	26,300	122,558.00	0.50
85	600507	方大特钢	15,600	121,680.00	0.49
86	600663	陆家嘴	11,200	121,632.00	0.49
87	600820	隧道股份	22,600	121,588.00	0.49
88	000563	陕国投 A	37,500	121,125.00	0.49
89	600498	烽火通信	6,700	120,466.00	0.49
90	002396	星网锐捷	5,100	120,207.00	0.49
91	000709	河钢股份	48,700	119,802.00	0.49
92	600928	西安银行	27,700	119,110.00	0.48
93	600166	福田汽车	34,600	119,024.00	0.48
94	601880	辽港股份	68,700	118,851.00	0.48
95	603613	国联股份	1,100	118,250.00	0.48
96	000685	中山公用	13,300	117,705.00	0.48
97	000528	柳工	15,200	117,192.00	0.48

98	600688	上海石化	27,500	114,675.00	0.47
99	002375	亚厦股份	15,300	114,597.00	0.47
100	600056	中国医药	9,700	114,557.00	0.47
101	002085	万丰奥威	20,500	112,545.00	0.46
102	000959	首钢股份	19,500	111,735.00	0.45
103	002266	浙富控股	15,600	111,072.00	0.45
104	600909	华安证券	20,300	109,823.00	0.45
105	002458	益生股份	9,700	109,707.00	0.45
106	002233	塔牌集团	10,300	108,974.00	0.44
107	600729	重庆百货	4,100	106,682.00	0.43
108	601000	唐山港	38,500	105,875.00	0.43
109	000488	晨鸣纸业	14,600	105,704.00	0.43
110	603355	莱克电气	3,600	105,552.00	0.43
111	002180	纳思达	2,200	105,072.00	0.43
112	600717	天津港	24,800	103,912.00	0.42
113	000960	锡业股份	4,700	91,791.00	0.37
114	300308	中际旭创	2,100	89,250.00	0.36
115	002368	太极股份	3,100	85,374.00	0.35
116	300223	北京君正	600	80,400.00	0.33
117	600649	城投控股	19,500	80,145.00	0.33
118	600188	兖矿能源	3,400	80,002.00	0.33
119	600177	雅戈尔	11,300	77,857.00	0.32
120	600754	锦江酒店	1,300	76,180.00	0.31
121	600985	淮北矿业	6,800	76,024.00	0.31
122	600885	宏发股份	1,000	74,640.00	0.30
123	600497	驰宏锌锗	13,900	69,361.00	0.28
124	603228	景旺电子	2,000	69,060.00	0.28
125	601997	贵阳银行	10,000	65,100.00	0.26
126	002532	天山铝业	7,300	59,495.00	0.24
127	600699	均胜电子	2,500	54,925.00	0.22
128	300168	万达信息	2,800	36,456.00	0.15

129	002444	巨星科技	900	27,459.00	0.11
130	600528	中铁工业	2,800	22,988.00	0.09
131	600643	爱建集团	3,300	22,308.00	0.09
132	603719	良品铺子	500	21,235.00	0.09
133	002155	湖南黄金	1,800	18,648.00	0.08
134	601992	金隅集团	4,000	11,360.00	0.05

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601728	中国电信	157,604	672,969.08	2.74
2	600089	特变电工	22,500	476,325.00	1.94
3	002074	国轩高科	5,400	276,750.00	1.13
4	002709	天赐材料	2,400	275,160.00	1.12
5	688200	华峰测控	400	204,760.00	0.83
6	600219	南山铝业	39,200	184,632.00	0.75
7	002648	卫星化学	4,400	176,132.00	0.72
8	600460	士兰微	3,200	173,440.00	0.71
9	601233	桐昆股份	7,700	163,086.00	0.66
10	600436	片仔癀	300	131,145.00	0.53
11	002461	珠江啤酒	13,500	122,850.00	0.50
12	300685	艾德生物	1,600	120,816.00	0.49
13	002839	张家港行	20,600	118,656.00	0.48
14	601801	皖新传媒	22,300	115,737.00	0.47
15	000538	云南白药	1,100	115,115.00	0.47
16	000501	鄂武商 A	10,900	114,559.00	0.47
17	300760	迈瑞医疗	300	114,240.00	0.46
18	000061	农产品	17,400	111,186.00	0.45
19	300896	爱美客	200	107,222.00	0.44



20	600276	恒瑞医药	2,100	106,491.00	0.43
21	603259	药明康德	780	92,492.40	0.38
22	601881	中国银河	7,000	78,330.00	0.32
23	300759	康龙化成	500	70,635.00	0.29
24	601868	中国能建	23,000	62,790.00	0.26
25	600779	水井坊	500	59,995.00	0.24
26	300852	四会富仕	900	52,578.00	0.21
27	000799	酒鬼酒	200	42,500.00	0.17
28	300504	天邑股份	1,700	32,878.00	0.13
29	603185	上机数控	100	16,698.00	0.07

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601233	桐昆股份	1,630,215.00	3.14
2	002013	中航机电	1,257,182.04	2.42
3	600820	隧道股份	1,194,155.00	2.30
4	600642	申能股份	1,191,891.00	2.30
5	601128	常熟银行	1,155,121.00	2.23
6	002092	中泰化学	1,153,917.00	2.23
7	600985	淮北矿业	1,150,537.00	2.22
8	000598	兴蓉环境	1,147,406.00	2.21
9	600089	特变电工	1,134,332.44	2.19
10	601098	中南传媒	1,128,071.00	2.18
11	603260	合盛硅业	1,074,904.00	2.07
12	600219	南山铝业	1,021,573.00	1.97
13	601728	中国电信	1,019,920.44	1.97
14	600884	杉杉股份	1,004,810.00	1.94
15	000830	鲁西化工	975,610.00	1.88

16	002081	金螳螂	954,807.00	1.84
17	600582	天地科技	945,141.00	1.82
18	000690	宝新能源	939,672.82	1.81
19	600201	生物股份	937,529.88	1.81
20	601598	中国外运	932,535.00	1.80

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600039	四川路桥	1,566,349.00	3.02
2	600642	申能股份	1,501,253.00	2.90
3	601098	中南传媒	1,423,411.00	2.75
4	002138	顺络电子	1,421,380.00	2.74
5	600549	厦门钨业	1,416,332.00	2.73
6	601233	桐昆股份	1,400,318.00	2.70
7	600141	兴发集团	1,387,018.00	2.68
8	002092	中泰化学	1,340,495.00	2.59
9	002408	齐翔腾达	1,286,119.00	2.48
10	600582	天地科技	1,239,609.00	2.39
11	300274	阳光电源	1,216,498.00	2.35
12	603613	国联股份	1,207,298.80	2.33
13	601615	明阳智能	1,202,735.00	2.32
14	601598	中国外运	1,197,364.00	2.31
15	600426	华鲁恒升	1,196,815.20	2.31
16	002013	中航机电	1,187,834.00	2.29
17	600089	特变电工	1,131,544.00	2.18
18	002353	杰瑞股份	1,119,812.01	2.16
19	300474	景嘉微	1,112,328.00	2.15
20	000983	山西焦煤	1,111,138.00	2.14

21	000830	鲁西化工	1,108,771.00	2.14
22	300496	中科创达	1,106,349.00	2.13
23	600497	驰宏锌锗	1,106,212.00	2.13
24	603260	合盛硅业	1,104,427.28	2.13
25	600884	杉杉股份	1,091,893.50	2.11
26	600765	中航重机	1,087,258.00	2.10
27	600985	淮北矿业	1,087,179.00	2.10
28	000598	兴蓉环境	1,084,266.00	2.09
29	002416	爱施德	1,080,780.00	2.08
30	601128	常熟银行	1,075,672.83	2.07
31	688099	晶晨股份	1,041,483.85	2.01
32	601318	中国平安	1,040,628.00	2.01
33	600820	隧道股份	1,038,705.00	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	172,884,995.94
卖出股票收入（成交）总额	196,361,294.55

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					92,427.18
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-50,440.00

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,052.13

2	应收证券清算款	2,082,282.93
3	应收股利	-
4	应收利息	350.20
5	应收申购款	3,013.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,091,699.17

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601728	中国电信	672,969.08	2.74	新股锁定

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有	户均持有的基金份	持有人结构
----	----------	-------

人户数 (户)	额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
443	39,501.90	8,502,505.33	48.59%	8,996,834.36	51.41%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	6,932.74	0.04%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月19日)基金份额总额	297,167,480.72
本报告期期初基金份额总额	42,675,767.60
本报告期基金总申购份额	3,463,115.76
减：本报告期基金总赎回份额	28,639,543.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,499,339.69

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

本基金本报告期投资策略未发生改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

2021年8月23日，本基金管理人改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为40,000元人民币。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	20,702,740.02	5.63%	15,139.96	4.81%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	2,542,108.01	0.69%	2,367.42	0.75%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	10,950,612.97	2.98%	10,198.34	3.24%	-
长江证券	2	30,397,641.43	8.26%	22,229.95	7.06%	-
东北证券	2	54,954,177.79	14.94%	40,187.49	12.77%	-
东方财富	2	-	-	-	-	-



东方 证券	2	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	-	-	-	-	-
东亚 前海 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	18,750,892.65	5.10%	17,462.64	5.55%	-
广发 证券	2	57,419,444.24	15.61%	53,474.95	16.99%	-
国金 证券	2	13,167,236.40	3.58%	12,262.90	3.90%	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华宝 证券	2	-	-	-	-	-
华福 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	32,718,358.75	8.90%	23,926.84	7.60%	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	39,398,266.23	10.71%	36,691.29	11.66%	-
上海 证券	2	82,505,559.28	22.43%	76,837.53	24.41%	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	4,317,062.70	1.17%	4,020.65	1.28%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-

注：

1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

（一）财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

（二）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

（四）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（五）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

2. 券商专用交易单元选择程序：

（一）券商席位由投资研究部业务人员推荐，经投资研究部、固定收益部、多资产投资

部会议讨论，形成重点评估的券商备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

(二) 投资研究部、固定收益部、多资产投资部全体业务人员遵照券商选择标准的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成券商排名及专用席位租用意见，报公司总经理批准。

(三) 公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议，明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

(四) 若签约券商的服务不能满足要求，或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚，公司可以提前终止签署的协议，并撤销租用的席位。

3. 在上述租用的券商交易单元中，(53905)华宝证券、(014726)华宝证券、(53614)东亚前海证券、(014261)东亚前海证券、(52636)中银国际证券、(013688)中银国际证券、(52899)华安证券、(48977)华安证券、(011542)华安证券、(000606)东海证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(48587)华福证券、(011075)华福证券、(40685)华泰证券、(48977)华安证券。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司关于旗下部分公募基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议有关条款的公告	规定媒介	2021-01-15
2	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-01-15
3	富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-01-15
4	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二一年第一号）	规定媒介	2021-01-15
5	富安达中证500指数增强型	规定媒介	2021-01-15

	证券投资基金基金产品资料概要更新		
6	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加国金证券费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-16
7	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2021-01-21
8	富安达中证500指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
9	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加农业银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-29
10	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-02-06
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-02-24
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-01
13	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-03
14	富安达基金管理有限公司关于暂停通过建设银行直联办理网上交易部分业务的通知	规定媒介	2021-03-05
15	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-10

16	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-11
17	富安达基金管理有限公司关于富安达中证500指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修订基金合同及托管协议部分条款的公告	规定媒介	2021-03-19
18	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-19
19	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-03-19
20	富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-03-19
21	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二一年第二号）	规定媒介	2021-03-19
22	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-24
23	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2021-03-29
24	富安达中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-29
25	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-04-08
26	富安达中证500指数增强型证券投资基金2021年第1季度报告	规定媒介	2021-04-21

27	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2021-04-21
28	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息技术有限公司为销售机构并与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-26
29	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-28
30	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-05-07
31	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-18
32	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万得基金为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-26
33	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-04
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
35	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
36	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-16

37	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-18
38	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-25
39	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-07-01
40	富安达基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	规定媒介	2021-07-08
41	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-07-14
42	富安达中证500指数增强型证券投资基金2021年第2季度报告	规定媒介	2021-07-20
43	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2021-07-20
44	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加粤开证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-07-24
45	富安达基金管理有限公司关于参加上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-07-29
46	富安达基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	规定媒介	2021-08-02

47	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-08-03
48	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-08-06
49	富安达基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	规定媒介	2021-08-14
50	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-08-20
51	富安达基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	规定媒介	2021-08-24
52	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-09-10
53	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-09-15
54	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-09-18
55	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-09-29
56	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-10-08
57	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-10-15



58	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二一年第三号）	规定媒介	2021-10-15
59	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2021-10-15
60	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-10-16
61	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2021-10-26
62	富安达中证500指数增强型证券投资基金2021年第3季度报告	规定媒介	2021-10-26
63	富安达基金管理有限公司关于参加国信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-11-25
64	富安达基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	规定媒介	2021-12-14
65	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-12-21
66	富安达基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-12-22
67	富安达基金管理有限公司关于旗下基金新增销售机构并参与费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-12-22
68	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-12-28
69	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2021-12-31

	于旗下部分基金新增国金证券为销售机构并参与其费率优惠活动的公告		
70	富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	规定媒介	2121-08-31
71	富安达中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告	规定媒介	2121-08-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210107-20210816	8,385,019.38	0.00	8,385,019.38	0.00	0.00%
	2	20210104-20211231	9,999,000.00	0.00	1,500,000.00	8,499,000.00	48.57%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的文件：
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二二年三月二十九日